

ABSTRAK

Tujuan penelitian ini adalah untuk mengetahui pengaruh *Net Profit Margin* (NPM), *Return On Investment* (ROI), dan *Earning Per Share* (EPS) terhadap *Return Saham*. Penelitian dilakukan dengan menggunakan objek pada perusahaan rokok yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia pada periode 2012 sampai 2016.

Metode pada penelitian ini menggunakan analisis regresi linier berganda, dimana terdapat uji asumsi klasik dan uji kelayakan model yang juga perlu dilakukan. Pengambilan sampel dilakukan dengan menggunakan metode *purposive sampling*. Data yang digunakan diambil dari laporan kinerja keuangan pada tahun 2012-2016.

Berdasarkan pengujian yang dilakukan dengan menggunakan analisis Uji t menyatakan bahwa variabel *Net Profit Margin* (NPM) dan *Return On Investment* (ROI) yang tidak berpengaruh terhadap *return* saham, dan hanya *Earning Per Share* (EPS) yang berpengaruh terhadap *return* saham pada perusahaan rokok yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia untuk periode 2012 sampai 2016.

Kata Kunci : NPM, ROI, EPS, *Return Saham*

ABSTRACT

The aim of this research was to find out the effect of Net Profit Margin (NPM), Return On Investment (ROI), and Earning Per Share (EPS) on shares return. The research sample used some cigarette companies which stated in Indonesia Stock Exchange in 2012-2016.

The data analysis used multiple regression linier, classical assumption test and proper test model. The sampling technique used purposive sampling and the data were taken from financial performance report in the year of 2012-2016.

Based on the T-test analysis, this research indicated that Net Profit Margin (NPM) and Return On Investment (ROI) variables did not affect on the shares return. On the other hand, only Earning Per Share (EPS) had affected shares return at some cigarette companies which stated in Indonesia Stock Exchange in 2012-2016.

Keywords: *NPM, ROI, EPS, Shares return*

